



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: junho de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

REND A FIXA									100,00%
-------------	--	--	--	--	--	--	--	--	---------

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	4,48	84.934.355,28	100,00	7.877.165.450,51	1,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,35	-0,02	0,61	4,48	84.934.355,28	100,00		
Renda Fixa			0,35	-0,02	0,61	4,48	84.934.355,28	100,00		
Total			0,35	-0,02	0,61	4,48	84.934.355,28	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	84.934.355,28	100,00	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	84.934.355,28	100,00					100,00
Total		84.934.355,28	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,61 77,18	4,48 85,89	1,97 77,69	4,48 85,89	10,79 92,31	1.401.959,41	12.477.819,17
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						1.401.959,41	12.477.819,17

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	127.741.591,31	175.123.299,72	-219.332.495,16	0,00	84.934.355,28	1.401.959,41	12.477.819,17
	127.741.591,31	175.123.299,72	-219.332.495,16	0,00	84.934.355,28	1.401.959,41	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

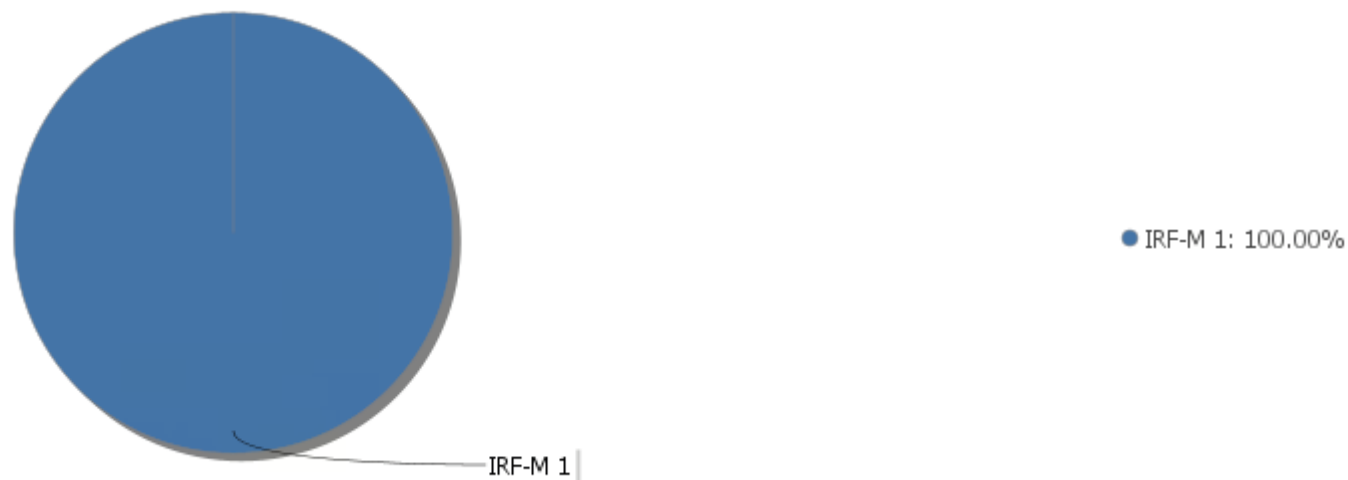
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	84.934.355,28	100,00	15,47	84.934.355,28	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	84.934.355,28	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,30	84.934.355,28	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

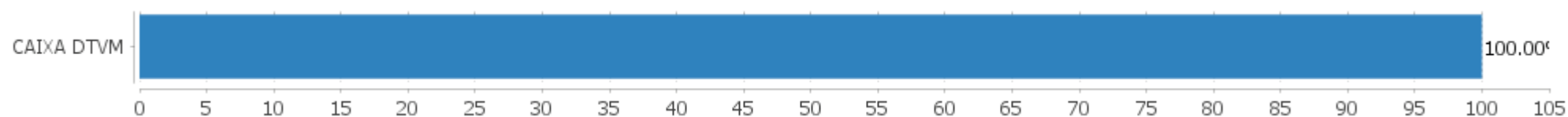


Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,91	0,74	0,80	0,58	0,76	0,61							4,48
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59							4,94
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25	-0,22	-0,10	0,01							-0,46
2023	1,12	0,97	1,21	0,84	1,12	1,16	1,07	1,11	0,91	0,94	0,97	0,89	13,02
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57	0,59	0,87	8,76
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91	0,62	0,52	0,34	0,37	0,38	0,01	4,27
2022	0,61	0,72	0,87	0,72	0,93	0,91	1,03	1,21	1,09	0,99	0,92	1,15	11,74
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04	0,90	0,72	0,97	10,00
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09	1,39	1,21	1,05	0,08	0,20	0,19	1,74
2021	0,03	0,02	0,01	0,28	0,17	0,19	0,17	0,34	0,38	-0,54	0,78	0,85	2,70
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33	1,41	1,11	0,91	12,25
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83	-0,51	-0,97	-0,70	-0,95	-1,94	-0,33	-0,06	-9,55
2020	0,42	0,36	0,59	0,43	0,39	0,26	0,24	0,10	0,13	0,14	0,22	0,28	3,63
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17	1,19	1,68	8,42
p.p. indexador	-0,11	-0,15	0,20	0,45	0,48	-0,31	-0,46	-0,45	-0,82	-1,03	-0,97	-1,39	-4,79

Performance Sobre a Meta Atuarial

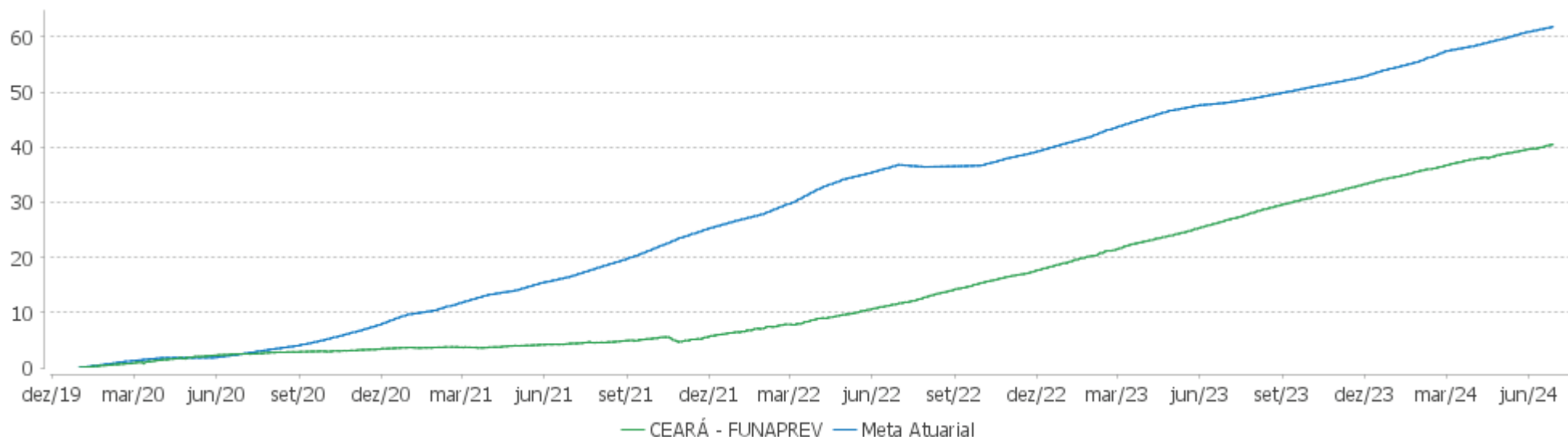
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	23	42,59
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	57,41
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

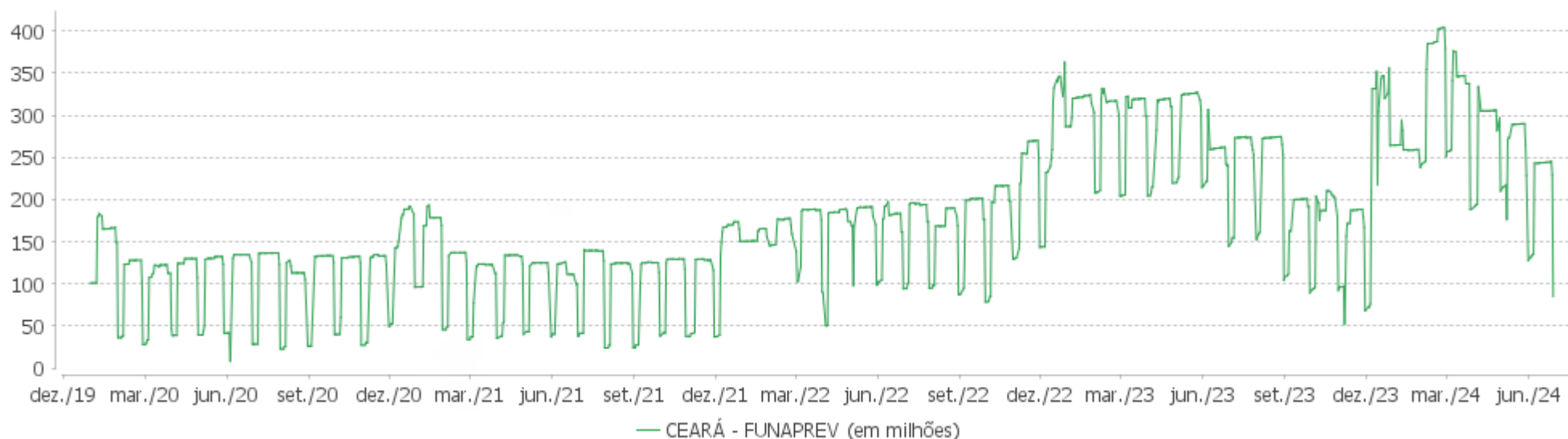
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,97	2,28	-0,31	0,54
06 meses	4,48	4,94	-0,46	0,41
12 meses	10,79	8,83	1,97	0,35
24 meses	25,84	16,74	9,10	0,37
36 meses	34,58	34,51	0,07	0,54
48 meses	37,03	49,93	-12,90	0,55
Desde 31/12/2019	40,44	52,80	-12,36	0,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

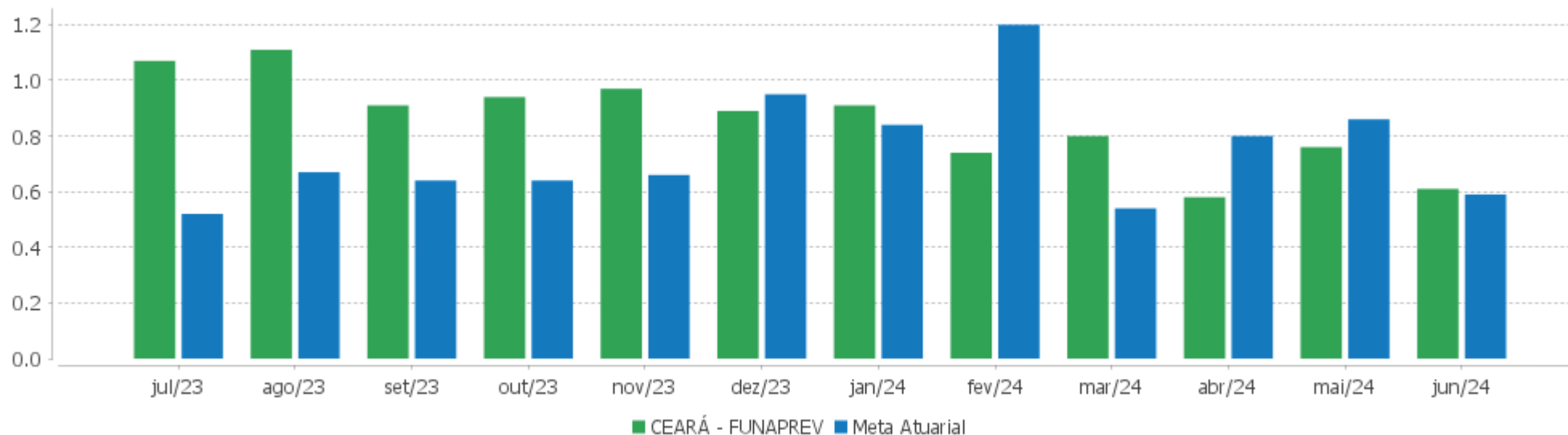


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,03	4,48 -0,02	1,97 -0,04	4,48 -0,02	10,79 -0,16	25,84 -0,44	34,58 -0,78
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,61 0,01	4,48 -0,46	1,97 -0,31	4,48 -0,46	10,79 1,48	25,84 7,52	34,58 -4,34
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3259	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.217,95	0,00	6.026,27391100	3,5209070000
3269	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.032.259,76	0,00	1.145.233,24813700	3,5209070000
3270	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.459.867,17	0,00	414.501,71650500	3,5219810000
3271	04/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	199.287,82518500	3,5219810000
3272	05/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.149.146,85	0,00	610.150,41777800	3,5223230000
3273	05/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	473,52	134,43198100	3,5223230000
3260	06/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.087,50	0,00	7.970,02278200	3,5241430000
3274	06/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.002,06	0,00	9.648,32017300	3,5241430000
3261	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	216.418,84	0,00	61.446,80430600	3,5220520000
3275	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	163.872.570,32	0,00	46.527.584,01068400	3,5220520000
3276	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	56.010.794,84	15.902.886,96387100	3,5220520000
3262	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.318,67	0,00	10.310,03337500	3,5226530000
3277	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.879,80	0,00	6.211,17095500	3,5226530000
3278	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.837,49	11.876,69861600	3,5226530000
3263	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.027,73	0,00	13.625,05028400	3,5249580000
3279	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.380,00	0,00	6.632,70314100	3,5249580000
3280	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.657,12	2.739,64092000	3,5249580000
3281	12/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.422,97	0,00	687,36932500	3,5249900000
3264	13/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.773,47	0,00	18.930,77174900	3,5272450000
3282	13/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.304,00	0,00	4.055,28960900	3,5272450000
3265	14/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	374,05360100	3,5289060000
3266	17/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.213,43	0,00	11.677,22705200	3,5293850000
3283	18/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.271,66	0,00	360,12385600	3,5311740000
3267	21/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.553,74865800	3,5365720000
3284	21/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.228,90	0,00	347,48338200	3,5365720000
3268	24/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.881,45	0,00	5.618,36188600	3,5386560000
3285	26/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	676.941,72	0,00	191.211,35051400	3,5402800000
3286	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.310,40	0,00	14.770,38592700	3,5415730000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3287	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.080.719,07	4.540.558,41015600	3,5415730000
3288	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.286.350,41	0,00	645.674,19687100	3,5410280000
3318	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	146.487.125,18	41.368.530,60184783	3,5410280000
Total			175.123.299,72	219.332.495,16		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 193.640,01

Value-At-Risk: 0,23%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,52	0,23	5,00	0,23	-0,35	0,61	84.934.355,28	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,23		0,23			84.934.355,28	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,23%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,23	0,23	0,02	-0,35	0,61	84.934.355,28	100,00
Sub-total	0,52	0,23	0,23		-0,35	0,61	84.934.355,28	100,00

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(5) Limite Política de Investimentos (%)